天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天弘新活力混合
基金主代码	001250
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2015年4月29日
报告期末基金份额总额	2,830,774,091.69份
投资目标	本基金力求通过资产配置和灵活运用多种投资策略,把握市场机会,在严格控制风险的前提下获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金采取灵活资产配置,主动投资管理的投资模式。在投资策略上,本基金从两个层次进行,首先是进行大类资产配置,在一定程度上尽可能地降低证券市场的系统性风险,把握市场波动中产生的投资机会;其次是采取自下而上的分析方法,从定量和定性两个方面,通过深入的基本面研究分析,精选具有良好投资价值的个股和个券,构建股票组合和债券组合。
业绩比较基准	50%×沪深300指数收益率+50%×中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于中等风险、中等收益预期的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	11,368,799.59
2.本期利润	39,162,428.93
3.加权平均基金份额本期利润	0.0164
4.期末基金资产净值	2,902,920,877.98
5.期末基金份额净值	1.0255

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

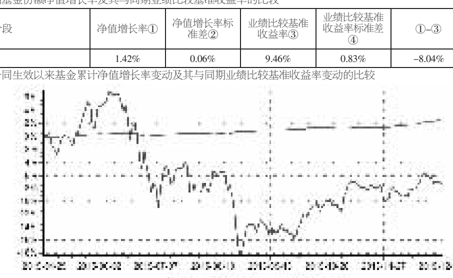
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.42%	0.06%	9.46%	0.83%	-8.04%	-0.77%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金合同于2015年4月29日生效。

2、基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2015年4月29日至2015年10月28日,建仓期结束时,各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

3、本报告期内,本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姜晓丽	本基金基金经理。	2015年4月	-	6年	女,经济学硕士。历任本公司债券研究员兼债券交易员;光大永明人寿保险有限公司债券研究员兼交易员;本公司固定收益研究员、天弘永利债券型证券投资基金基金经理助理。
钱文成	本基金基金经理。	2015年4月	-	9年	男,理学硕士。2007年5月加盟本公司,历任行业研究员、高级研究员、策略研究员、研究主管助理、研究部副主管、研究副总监、研究总监、股票投资部副总经理、天弘精选混合型证券投资基金基金经理助理。

注:1、上述任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括:建立统一的研究平台和公共信息平台,保证各组合得到公平的投资资讯;公平对待不同投资组合,禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动;在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,严格执行授权审批程序;实行集中交易制度和公平交易分配制度;建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度,保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离;加强对投资交易行为的监察稽核力度,建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内,公司公平交易程序运作良好,未出现异常情况;场外、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为,公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为,公平对待投资组合,制定《异常交易监控和报告办法》对可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行界定,拟定相应的监控、分析和防控措施。

本报告期内,严格控制同一基金或不同基金组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易;针对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控,保证分配结果符合公平交易原则。未发现本基金存在异常交易行为。

本基金本报告期内未发生同一基金或不同基金组合之间在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年4季度,经济基本面整体延续疲弱,虽然后半段经济有一定企稳迹象,但是弱势格局短期内无法根本性扭转。以基建投资扩张为核心的经济托底政策,无法充分对冲内需快速回落的冲击,只能在一定程度上延缓经济增速回落的速度,无法扭转整体的趋势。政策方面,经济下行压力大以及外汇流出加剧等因素使得货币政策依然处于宽松途中,央行于四季度继续进行了降准降息等宽松操作,呵护二季度以来流动性的宽松局面。资金面方面,得益于央行构建利率走廊的政策意图,资金利率稳定性显著提升。在基本面、政策面和资金面三方配合,以及资产荒格局下增量资金的涌入,债券收益率出现显著下行,尤其是利率债收益率一举突破前期低点,走出了一轮牛市。从股票市场来看,4季度也走出了一轮较好的行情。

本基金在报告期内,以债券仓位为主,同时也持有部分股票参与二级市场的机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止2015年12月31日,本基金的基金份额净值为1.0255元,本报告期份额净值增长率为1.42%,同期业绩比较基准增长率为9.46%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年1季度,基本面方面,虽然前期稳增长政策的累积效应逐渐显现,对经济有一定支撑作用,但是经济下行压力仍存,且中央有意推进供给侧结构性改革,去产能过程将对经济增长形成进一步冲击,并且对CPI通胀也将形成制约,基本面对债市仍属利好。政策方面,虽然目前货币政策有转趋稳健的迹象,但在经济杠杆率较高、企业还本付息压力仍大的情况下宽松基调仍是应有之义,预计货币政策仍将维持稳健偏松态势。资金面方面,央行对于资金面的控制能力已经经过2015年的多重考验,而且目前央行也有动力维持资金面稳定,因此2016年资金面仍将维持相对稳定的态势,如果后续有进一步降息的操作,当前相对较高的资金利率大概率也将相应下调,从而打开债券收益率进一步下行的空间。除此之外,我们认为资产稀缺的状况难以发生根本性的扭转,资产荒的状况依旧具有持续性,债市仍有增量资金入场。综合以上因素,债券市场一季度行情整体仍将趋暖。

投资策略上,本基金将继续以债券仓位为主,同时积极参与一级市场打新的机会,并且适当精选个股参与二级市场的机会。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	77,699,212.45	2.57
	其中:股票	77,699,212.45	2.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,511,830,895.74	83.01
	其中:债券	2,511,830,895.74	83.01
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	400,000,800.00	13.22
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,564,536.00	0.32
8	其他资产	26,730,105.47	0.88
9	合计	3,025,825,549.66	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	65,135,675.87	2.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,074,955.00	0.24
E	建筑业	1,571,551.95	0.05
F	批发和零售业	222,304.44	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,602,608.58	0.09
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	109,392.21	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	982,724.40	0.03
S	综合	-	-
	合计	77,699,212.45	2.68

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600660	福耀玻璃	900,600	13,680,114.00	0.47
2	000858	五粮液	493,800	13,470,864.00	0.46
3	002415	海康威视	355,097	12,211,785.83	0.42
4	600010	包钢股份	3,081,932	11,125,774.52	0.38
5	000651	格力电器	415,500	9,286,425.00	0.32
6	600886	国投电力	847,300	7,074,955.00	0.24
7	603508	思维列控	14,790	1,151,253.60	0.04
8	603800	道森股份	19,344	1,043,221.92	0.04
9	603999	读者传媒	16,713	982,724.40	0.03
10	300496	中科创达	6,560	918,465.60	0.03

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	160,236,000.00	5.52
	其中:政策性金融债	160,236,000.00	5.52
4	企业债券	630,103,690.41	21.71
5	企业短期融资券	511,248,000.00	17.61
6	中期票据	1,200,008,000.00	41.34
7	可转债	10,235,205.33	0.35
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,511,830,895.74	86.53

注:可转债包含可交换债9,583,248.20元。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1380258	13黔南债	1,200,000	128,664,000.00	4.43
2	101554095	15成渝高速MTN001	1,200,000	120,024,000.00	4.13
3	101355011	13赣州发展MTN001	1,000,000	118,050,000.00	4.07
4	011599509	15南山集SCP001	1,000,000	100,390,000.00	3.46
5	150413	15农发13	1,000,000	100,110,000.00	3.45

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查,未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2 基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.11.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	159,945.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,420,168.11
5	应收申购款	149,992.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,730,105.47

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,915,530,029.81
报告期期间基金总申购份额	1,068,397,327.54
减:报告期期间基金总赎回份额	153,153,265.66
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	2,830,774,091.69

注:总申购份额含转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,200.02
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,200.02
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.35

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,200.02	0.35%	10,000,200.02	0.35%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,200.02	0.35%	10,000,200.02	0.35%	

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金的文件

2、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同

3、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书

4、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议

5、天弘基金管理有限公司批准成立批件及营业执照

9.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的住所及网站或基金托管人的住所免费查阅备查文件,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站:www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇一六年一月二十二日

天弘现金管家货币市场基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期:2016年01月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天弘现金管家货币			
基金主代码	420006			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2012年06月20日			
报告期末基金份额总额	7,087,860,896.45份			
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。			
投资策略	本基金根据对短期利率变动的预测,采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略,利用定性分析和定量分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保证流动性的基础上,力争获得稳定的当期收益。			
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)			
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。			
基金管理人	天弘基金管理有限公司			
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司			
下属分级基金的基金简称	天弘现金管家货币A类	天弘现金管家货币B类	天弘现金管家货币C类	天弘现金管家货币D类
下属分级基金的交易代码	420006	420106	000832	001251
报告期末下属分级基金的份额总额	89,765,593.48	6,354,300,166.41	605,355,815.34	38,439,321.22

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月01日-2015年12月31日)			
	天弘现金管家货币A类	天弘现金管家货币B类	天弘现金管家货币C类	天弘现金管家货币D类
1.本期已实现收益	469,752.14	40,258,156.86	3,196,080.10	82,531.81
2.本期利润	469,752.14	40,258,156.86	3,196,080.10	82,531.81
3.期末基金资产净值	89,765,593.48	6,354,300,166.41	605,355,815.34	38,439,321.22

注:1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、天弘现金管家货币A类

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5238%	0.0034%	0.3456%	0.0000%	0.1782%	0.0034%

2、天弘现金管家货币B类

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5847%	0.0034%	0.3456%	0.0000%	0.2391%	0.0034%

3、天弘现金管家货币C类

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5365%	0.0034%	0.3456%	0.0000%	0.1909%	0.0034%

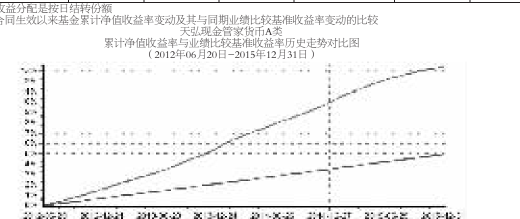
4、天弘现金管家货币D类

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5244%	0.0034%	0.3456%	0.0000%	0.1788%	0.0034%

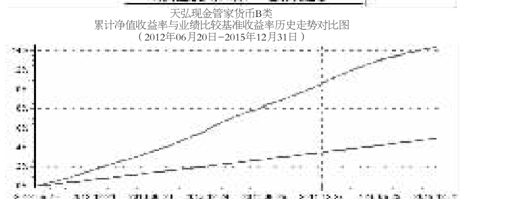
注:本基金的收益分配是按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

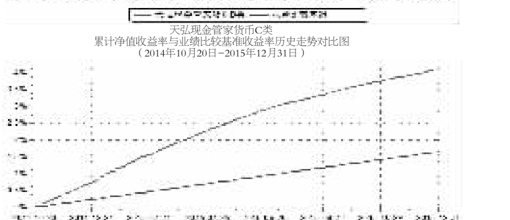
天弘现金管家货币A类
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年06月20日-2015年12月31日)



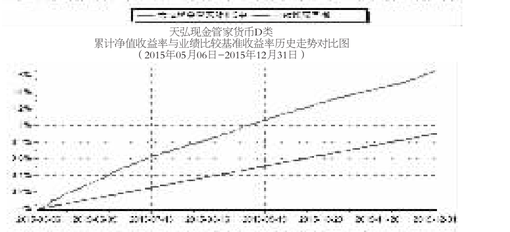
天弘现金管家货币B类
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年06月20日-2015年12月31日)



天弘现金管家货币C类
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2014年10月20日-2015年12月31日)



天弘现金管家货币D类
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年05月06日-2015年12月31日)



注:1、本基金合同于2012年6月20日生效。

2、本基金于2014年10月15日起增加天弘现金管家货币C类基金份额,并于2014年10月20日起办理该类份额的申购和赎回业务。

3、本基金于2015年5月5日起增加天弘现金管家货币D类基金份额,并于2015年5月6日起办理该类份额的申购和赎回业务。

4、本报告期内,本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王登峰	本基金基金经理。	2012年08月08日	-	6年	男,经济学硕士。历任中信建投证券股份有限公司固定收益部高级经理。2012年加盟本公司,历任固定收益研究员。

注:1、上述任职日期为本基金管理人对外披露的任职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括:建立统一的研究平台和公共信息平台,保证各组合得到公平的投资资讯;公平对待不同投资组合,禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动;在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,严格执行授权审批程序;实行集中交易制度和公平交易分配制度;建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度,保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离;加强对投资交易行为的监察稽核力度,建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内,公司公平交易程序运作良好,未出现异常情况;场外、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为,公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为,公平对待投资组合,制定《异常交易监控和报告办法》对可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行界定,拟定相应的监控、分析和防控措施。

本报告期内,严格控制同一基金或不同基金组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易;针对以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控,保证分配结果符合公平交易原则。未发现本基金存在异常交易行为。

本基金本报告期内未发生同一基金或不同基金组合之间在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年4季度,经济基本面整体延续疲弱,虽然后半段经济有一定企稳迹象,但是弱势格局短期内无法根本性扭转。以基建投资扩张为核心的经济托底政策,无法充分对冲内需快速回落的冲击,只能在一定程度上延缓经济增速回落的速度,无法扭转整体的趋势。政策方面,经济下行压力大以及外汇流出加剧等因素使得货币政策依然处于宽松途中,央行于四季度继续进行了降准降息等宽松操作,呵护二季度以来流动性的宽松局面。资金面方面,得益于央行构建利率走廊的政策意图,资金利率稳定。在基本面、政策面和资金面三方配合,以及资产荒格局下增量资金的涌入,资金利率和债券收益率出现显著下行。

本基金在报告期内,根据组合持有人结构的特点动态调整组合中资产配置的比例,适度加大了债券配置力度,以提升组合流动性。本基金在报告期内为持有人创造了合理的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止2015年12月31日,本基金A级份额本报告期净值收益率为0.5238%,B级份额净值收益率为0.5847%,C级份额净值收益率为0.5365%,D级份额净值收益率为0.5244%,同期业绩比较基准收益率为0.3456%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年1季度,基本面方面,虽然前期稳增长政策的累积效应逐渐显现,对经济有一定支撑作用,但是经济下行压力仍存,且中央有意推进供给侧结构性改革,去产能过程将对经济增长形成进一步冲击,并且对CPI通胀也将形成制约,基本面对债市仍属利好。政策方面,虽然目前货币政策有转趋稳健的迹象,但在经济杠杆率较高、企业还本付息压力仍大的情况下宽松基调仍是应有之义,预计货币政策仍将维持稳健偏松态势。资金面方面,央行对于资金面的控制能力已经经过2015年的多重考验,而且目前央行也有动力维持资金面稳定,因此2016年资金面仍将维持相对稳定的态势,如果后续有进一步降息的操作,当前相对较高的资金利率大概率也将相应下调,从而打开债券收益率进一步下行的空间。

投资策略上,本基金将继续秉承"稳健理财"的投资理念,在控制好流动性风险、价格风险及信用风险的基础上,灵活调整组合资产持有比例,继续为持有人创造合理的收益。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	5,071,993,448.18	63.16
	其中:债券	5,071,993,448.18	63.16
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	739,001,348.50	9.20
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,323,657,941.78	16.48
4	其他资产	895,533,376.63	11.15
5	合计	8,030,186,115.09	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目		占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额		2.47
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	938,599,405.00	13.24
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值比例应取报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值;对于货币市场基金,只要其投资的市场(如银行间市场)可交易,即可视为交易日。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	56
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	57
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	28

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

根据本货币市场基金基金合同的约定,其投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过120天。本报告期内,本货币市场基金投资组合平均剩余期限未发生超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	54.07	13.24
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	17.07	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	3.81	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	18.56	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	7.15	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	100.66	13.24

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	418,465,478.30	5.90
2	央行票据	-	-
3	金融债券	200,074,705.17	2.82
	其中:政策性金融债	200,074,705.17	2.82
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,912,924,297.73	41.10
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,540,528,966.98	21.73
8	其他	-	-
9	合计	5,071,993,448.18	71.56
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111508214	15中信CD214	7,000,000	694,679,398.32	9.80
2	011598117	15中电信SCP005	4,000,000	399,938,373.49	5.64
3	111514064	15江苏银行CD064	4,000,000	399,223,496.10	5.63
4	011590007	15苏交通SCP007	2,800,000	280,043,101.47	3.95
5	011599467	15中电信SCP004	2,400,000	240,021,454.12	3.39
6	111509232	15浦发CD232	2,000,000	199,845,803.31	2.82
7	111508215	15中信CD215	2,000,000	196,932,431.63	2.78
8	011599331	15五矿SCP007	1,800,000	180,189,200.64	2.54
9	011599850	15首旅SCP005	1,800,000	179,997,932.09	2.54
10	041554007	15洋河CP001	1,200,000	120,302,542.94	1.70

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1807%
报告期内偏离度的最低值	0.0784%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1082%

注:表内各项数据均按报告期内的交易日统计。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明。

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销,每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额净值保持在人民币1.00元。

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果,基金管理人于每一估值日,采用估值技术,对基金持有的估值对象进行重新评估,即"影子定价"。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的,应按其他公允指标对组合的账面价值进行调整,调整差额确认为"公允价值变动损益",并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至1.00元,可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

5.8.2

本报告期内,本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。

5.8.3 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查,未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.8.4 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	833,888.35
3	应收利息	44,105,970.38
4	应收申购款	850,593,517.90
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	895,533,376.63

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	天弘现金管家货币A类	天弘现金管家货币B类	天弘现金管家货币C类	天弘现金管家货币D类
基金合同生效日基金份额总额	576,166,940.77	658,270,316.20	-	-
报告期期初基金份额总额	94,178,391.95	5,587,086,625.54	618,455,727.93	15,737,568.98
报告期期间基金总申购份额	87,330,625.63	9,942,781,137.54	1,621,438,522.91	28,820,476.71
减:报告期期间基金总赎回份额	91,743,424.10	9,175,567,596.67	1,634,538,435.50	6,118,724.47
报告期期末基金份额总额	89,765,593.48	6,354,300,166.41	605,355,815.34	38,439,321.22

注:1、总申购份额含红利再投、分级调整转入及转换入份额。

2、总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期末有基金管理人运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准天弘现金管家货币市场基金募集的文件

2、天弘现金管家货币市场基金基金合同

3、天弘现金管家货币市场基金招募说明书

4、天弘现金管家货币市场基金托管协议

5、天弘基金管理有限公司批准成立批件及营业执照

8.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的住所及网站或基金托管人的住所免费查阅备查文件,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站:www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇一六年一月二十二日

天弘稳利定期开放债券型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年01月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天弘稳利定期开放	
基金主代码	000244	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年07月19日	
报告期末基金份额总额	275,086,560.14份	
投资目标	在追求本金安全的基础上,力求获取较高的当期收益。	
投资策略	本基金通过对宏观经济、利率走势、资金供求、信用风险状况、证券市场走势等方面的分析和预测,采取自上而下和自下而上相结合的投资策略,构建和调整固定收益证券投资组合,力求获得稳健的投资收益。	
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率(税后)×1.4	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	天弘稳利定期开放A	天弘稳利定期开放B
下属分级基金的交易代码	000244	000245
报告期末下属分级基金的份额总额	157,591,891.82份	117,494,668.32份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月01日-2015年12月31日)	
	天弘稳利定期开放A	天弘稳利定期开放B
1.本期已实现收益	3,116,543.14	2,168,071.75
2.本期利润	6,405,989.52	4,604,469.19
3.加权平均基金份额本期利润	0.0406	0.0392
4.期末基金资产净值	191,965,259.19	142,131,426.16
5.期末基金份额净值	1.218	1.210

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

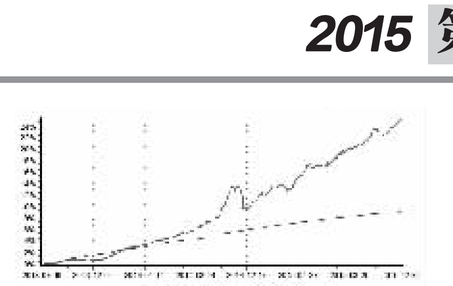
天弘稳利定期开放A

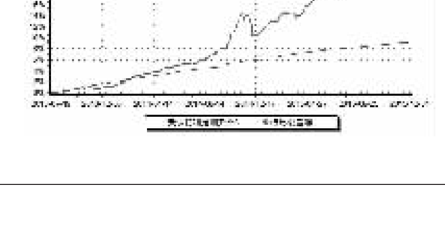
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.48%	0.11%	0.51%	0.01%	2.97%	0.10%

天弘稳利定期开放B

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.42%	0.11%	0.51%	0.01%	2.91%	0.10%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:1、本基金合同于2013年7月19日生效。

2、本报告期内,本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈钢	本基金基金经理;本公司副总经理、固定收益总监兼固定收益部总经理。	2013年07月		13年	男,工商管理硕士。历任华龙证券公司固定收益部高级经理;北京宸星投资管理公司投资经理;兴业证券公司债券总部研究部经理;银华基金管理有限公司机构理财部高级经理;中国人寿资产管理有限公司固定收益部高级投资经理。2011年加盟本公司,历任天弘永利债券型证券投资基金基金经理。
姜晓丽	本基金基金经理。	2013年07月		6年	女,经济学硕士。历任本公司债券研究员兼债券交易员;光大永明人寿保险有限公司债券研究员兼交易员;本公司固定收益研究员、天弘永利债券型证券投资基金基金经理助理。

注:1、上述任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括:建立统一的研究平台和公共信息平台,保证各组合得到公平的投资资讯;公平对待不同投资组合,禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动;在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,严格执行授权审批程序;实行集中交易制度和公平交易分配制度;建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度,保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离;加强对投资交易行为的监察稽核力度,建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内,公司公平交易程序运作良好,未出现异常情况;场外、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为,公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为,公平对待投资组合,制定《异常交易监控和报告办法》对可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行界定,拟定相应的监控、分析和防控措施。

本报告期内,严格控制同一基金或不同基金组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易;针对以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控,保证分配结果符合公平交易原则。未发现本基金存在异常交易行为。

本基金本报告期内未发生同一基金或不同基金组合之间在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年四季度,经济基本面整体延续疲弱,虽然后半段经济有一定企稳迹象,但是弱势格局短期内无法根本性扭转。以基建投资扩张为核心的经济托底政策,无法充分对冲内需快速回落的冲击,只能在一定程度上延缓经济增速回落的速度,无法扭转整体的趋势。政策方面,经济下行压力大以及外汇流出加剧等因素使得货币政策依然处于宽松途中,央行于四季度继续进行了降准降息等宽松操作,呵护二季度以来流动性的宽松局面。资金面方面,得益于央行构建利率走廊的政策意图,资金利率稳定性显著提升。在基本面、政策面和资金面三方配合,以及资产荒格局下增量资金的涌入,债券收益率出现显著下行,尤其是利率债收益率一举突破前期低点,走出了一轮牛市。

由于本基金在报告期内属于封闭期,因此在组合上主要维持久期匹配和较高杠杆,总体持仓较为稳定,同时结合对市场的判断进行适当加仓,总体为客户创造了较高的稳健收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止2015年12月31日,本基金A级份额本报告期净值收益率为3.48%,B级份额净值收益率为3.42%,同期业绩比较基准收益率为0.51%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年一季度,基本面方面,虽然前期稳增长政策的累积效应逐渐显现,对经济有一定支撑作用,但是经济下行压力仍存,且中央有意推进供给侧结构性改革,去产能过程将对经济增长形成进一步冲击,并且对CPI通胀也将形成制约,基本面对债市仍属利好。政策方面,虽然目前货币政策有转趋稳健的迹象,但在经济杠杆率较高、企业还本付息压力仍大的情况下宽松基调仍是应有之义,预计货币政策仍将维持稳健偏松态势。资金面方面,央行对于资金面的控制能力已经经过2015年的多重考验,而且目前央行也有动力维持资金面稳定,因此2016年资金面仍将维持相对稳定的态势,如果后续有进一步降息的操作,当前相对较高的资金利率大概率也将相应下调,从而打开债券收益率进一步下行的空间。除此之外,我们认为资产稀缺的状况难以发生根本性的扭转,资产荒的状况依旧具有持续性,债市仍有增量资金入场。综合以上因素,债券市场一季度行情整体仍将趋暖。

投资策略上,本基金将维持组合久期的匹配以及适度的杠杆水平,同时根据经济形势可能会有所变化的判断,密切跟踪国内、国际经济形势,及时对组合仓位和久期进行调整,争取继续为投资者贡献稳健正收益。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	497,295,734.90	96.35
	其中:债券	497,295,734.90	96.35
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,317,802.30	1.42
8	其他资产	11,525,882.22	2.23
9	合计	516,139,419.42	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	372,594,669.90	111.52
5	企业短期融资券	20,086,000.00	6.01
6	中期票据	102,768,000.00	30.76
7	可转债	1,847,065.00	0.55
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	497,295,734.90	148.85

注:可转债项下包含可交换债725,650.00元。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1480291	14银开发债	400,000	44,948,000.00	13.45
2	1480234	14鹤投资债	400,000	44,084,000.00	13.19
3	1480321	14汤山建投债	400,000	43,580,000.00	13.04
4	1380296	13鄂供销债	400,000	42,656,000.00	12.77
5	1480381	14南宁绿港债	200,000	21,928,000.00	6.56

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查,未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2 本基金本报告期末未持有股票,故不存在所投资的前十名股票中超出基金合同规定之备选股票库的情况。

5.11.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,965.80
2	应收证券清算款	392,702.31
3	应收股利	-
4	应收利息	11,127,214.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,525,882.22

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	586,474.20	0.18
2	110031	航信转债	534,940.80	0.16

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	天弘稳利定期开放A	天弘稳利定期开放B
报告期期初基金份额总额	157,591,891.82	117,494,668.32
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	157,591,891.82	117,494,668.32

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准天弘稳利定期开放债券型证券投资基金募集的文件

2、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金基金合同

3、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金招募说明书

4、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金托管协议

5、天弘基金管理有限公司批准成立批件及营业执照

8.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的注册登记地及网站或基金托管人的注册登记地免费查阅备查文件,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站:www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇一六年一月二十二日